

Webcast

Formación Estratégica de Portafolios de Inversión

Descripción

Presentación vía web donde se mostrará desde una perspectiva práctica el uso de herramientas y modelos recientes para formular prudentemente portafolios de inversión incluyendo factores de riesgo de mercado. Además, se mostrarán los principales indicadores estratégicos para la selección de portafolios en relación con el perfil del inversionista.

Dirigido a

Gerentes Financieros, Analistas de Riesgos, Comisionistas, Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías, Administradores de Mesas de Dinero, Fideicomisos, Universidades y en general aquellas personas interesadas en una herramienta práctica que permita optimizar y analizar el riesgo de portafolios de inversión aplicando tanto modelos tradicionales de valoración como modernos.

Objetivo

1. Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización de portafolios empleando indicadores de riesgo clásicos (simétricos) y modernos (asimétricos).
2. Mostrar la manera eficiente de construir y gestionar portafolios de inversión en una situación real de mercado.

Temario

1. Estrategias de Inversión.
2. Teoría Moderna de Portafolio.
 - a. Funciones de Utilidad.
 - b. Cálculo de rentabilidad y riesgo.
 - c. Cálculo de covarianzas y correlaciones entre activos.
 - d. Frontera Eficiente.
 - e. Capital Allocation Line (CAL).
3. Principales indicadores estratégicos de inversión.
 - a. Índice de Sharpe.
 - b. Omega de Keating.
 - c. Función de utilidad del inversionista.
 - d. Índice Herfindahl-Hirschman.
 - e. Conditional Value at Risk (CVaR).

Instructores

Franco Andrés Mansilla Ibañez

Ingeniero Civil Industrial con Magister en Finanzas en la Universidad de Chile. Actualmente, se encuentra trabajando como Analista Gestión de Riesgo Senior del Banco Santander en Chile. Se ha desempeñado como Analista en Investigación Económica y Financiera para académicos de la Universidad de Chile y Banco Central de Chile en temas de Mercados de Capitales, Eficiencia de Mercado, Riesgo Financiero, Econometría y Estadística. En el área académica ha sido catedrático en temas como: Probabilidad y Estadística, Econometría Financiera, Formulación y Evaluación de Proyecto, y en ramas de ingeniería como Investigación de Operaciones y Taller de Ingeniería Civil Industrial.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Vie. 05 de Oct de 2018

Horarios

08:00 a.m San José de Costa Rica

09:00 a.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima

10:00 a.m La Paz - Caracas

11:00 a.m Buenos Aires - Santiago de Chile

Herramientas de apoyo



Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora